



XONTRO Newsletter

Kreditinstitute Nr. 62

Dieser Newsletter enthält Informationen

- Platzdirektgeschäfte bei verlängerter Handelszeit an der Börse Stuttgart
- Bilaterale Aggregation

## 1. Platzdirektgeschäfte bei verlängerter Handelszeit an der Börse Stuttgart

Wie wir im Newsletter Nr. 61 mitgeteilt haben, wird die Börse Stuttgart die Handelszeit in verschiedenen Märkten ab dem 1. März 2013 auf 22:00 Uhr ausdehnen.

Anders als im letzten Newsletter angekündigt, wird es möglich sein, Platzdirektgeschäfte sowie taggleiche Stornierungen von Platzdirektgeschäften am Börsenplatz Stuttgart bis 22:15 Uhr zu erfassen. Dies gilt für alle Erfassungswege (SAKI SWIFT, SAKI FIX, Dialog). Platzdirektgeschäfte an anderen Börsenplätzen und PUEV-Geschäfte sind davon unberührt und können weiterhin nur bis 20.40 Uhr in XONTRO eingestellt werden.

Aufgrund von Rückfragen haben wir die aktuellen Systemzeiten nochmals tabellarisch zusammengestellt:

<b>Verfügbarkeit der Systeme / Lieferung der Listen und Protokolle (Richtwerte)</b>	<b>bisher alle Börsen</b> <small>(sofern Xontro und nicht MaxOne)</small>	<b>zukünftig EDS</b>	<b>zukünftig EDB, EDD, EDH, EDI, EDM</b> <small>(sofern Xontro und nicht MaxOne)</small>
	<b>Uhrzeit</b>	<b>Uhrzeit</b>	<b>Uhrzeit</b>
Ende Börsenzeit	20:00	22:00	20:00
Eingabeende Xontro Trade (Makler)	20:40	22:15	20:40
Eingabeende Xontro Order (Makler)	20:40	22:15	22:15
Versenden der Nachricht BOEND	20:55	22:45	22:45
Systemstart ca.	01:00	02:00	02:00
<b>XONTRO ORDER</b>			
Kurseingabeende, Quote	20:00	22:00	20:00
Nachbearbeitung	20:40	22:15	20:40
Eingabe-Ende Orderrouting	20:45	22:20	22:20
Nebenrechtsverarbeitung (inkl. evtl. Orderlöschung) ca.	20:40	22:45	22:45
<b>XONTRO TRADE</b>			
Eingabe-Ende PUEV	20:40	20:40	20:40
Eingabe-Ende sowie Storno (taggleich) für Bankdirektgeschäfte	20:40	22:15	20:40
Storno-Ende Bank/Makler (Folgetag)	15:00	15:00	15:00
Empfang von Ausführungsnachrichten und Realtime-SNO möglich bis	20:50	22:30	22:30 <small>(wenn Filiale in EDS)</small>
MiFID Posttrade Meldungen möglich bis	20:40	20:40	20:40

<b>Verfügbarkeit der Systeme / Lieferung der Listen und Protokolle (Richtwerte)</b>	<b>bisher alle Börsen</b> (sofern Xontro und nicht MaxOne)	<b>zukünftig EDS</b>	<b>zukünftig EDB, EDD, EDH, EDI, EDM</b> (sofern Xontro und nicht MaxOne)
	<b>Uhrzeit</b>	<b>Uhrzeit</b>	<b>Uhrzeit</b>
<b>INVESTRO</b>			
Zugang und Verarbeitung stehen zur Verfügung bis ca.	20:40	20:40	20:40
Investro Stornoende	15:00	15:00	15:00
<b>EUFO</b>			
Zugang und Verarbeitung stehen zur Verfügung bis ca.	20:40	20:40	20:40
<b>Listen und Protokolle (Richtwerte)</b>			
Erstellung der Maklerunterlagen beginnt nach dem Eingabeende bis ca.	20:45 - 23:00	22:15 - 00:30	20:45 - 23:00
Schlussnotenerstellung (jeweils letzter Lauf)			
- stündliche SNO	20:50	20:50	20:50
- viertelstündlich SNO	20:50	20:50	20:50
- Clearer-SNO	20:50	20:50	20:50
- zusätzlicher SNO-Endlauf Banken		22:30	22:30 (wenn Filiale in EDS)
- zusätzlicher SNO-Endlauf Clearer		22:30	22:30 (wenn Filiale in EDS)
Gedruckte Schlussnoten werden wie bisher am Folgetag bereitgestellt.			
Courtage-Liste	20:50	22:30 (sofern vorhanden)	22:30
Kursdifferenz-Liste	20:50	22:30	22:30
Aufgaben-Liste	20:50	22:15	20:50
Engagementkontrolle	20:50	22:15	20:50
Maklertagebuch	20:50	22:15	20:50
HUM-Informationsliste	20:50	22:15	20:50
Verrechnungsbeträge	20:50	22:30	20:50
Entgelt-Liste	21:45	23:15	21:45
Fixiertes Orderbuch	21:30	23:15	23:15
Protokoll Maklereingaben	23:30	00:30	00:30
Orderbestandsliste / Orderbestandsabgleich	23:10	00:15	00:15
Orderhistorie (Bank, Investro, Makler)	21:30	23:30	23:30
File Historische Nachrichten	23:15	00:15	00:15

## **2. Bilaterale Aggregation**

Es ist geplant, im ersten Quartal 2013 auch in XONTRO die Möglichkeit der bilateralen Aggregation einzuführen. Jeder Teilnehmer hat die Möglichkeit, ein Set von CBF-Nummern zu definieren, für welche Geschäfte untereinander aggregiert werden. Untertägig werden – wie bisher – sogenannte „Handelsschlussnoten“ erstellt und versandt, die einen Hinweis tragen, dass sie am Abend in die Aggregation einfließen. Am Abend werden dann die „Abwicklungsschlussnoten“ erstellt, die im Gegensatz zu den Handelsschlussnoten an die Clearstream übergeben werden.

Zusätzlich wird ein Report erstellt, aus dem ersichtlich ist, welche Handelsschlussnoten zu welcher Abwicklungsschlussnote geführt haben.

Nähere Informationen zum Thema „bilaterale Aggregation“ erhalten Sie in einem späteren Newsletter.